

# 南方亚洲美元收益债券型证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 03 月 29 日

## 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

## 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方亚洲美元收益债券型证券投资基金	
基金简称	南方亚洲美元收益债券（QDII）	
基金主代码	002400	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 3 月 3 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3, 110, 262, 751. 10 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方亚洲美元债 A	南方亚洲美元债 C
下属分级基金的交易代码	002400	002401
报告期末下属分级基金的份 额总额	2, 264, 654, 590. 94 份	845, 608, 160. 16 份

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下, 可简称为“南方亚洲美元债”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过分析亚洲区域各国家和地区的宏观经济状况以及发债主体的微观基本面, 寻找各类债券的投资机会, 在谨慎前提下力争实现长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金将根据宏观经济、基准利率水平, 分析债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平, 结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析, 做出最佳的资产配置及风险控制。本基金采用自上而下的宏观分析和自下而上的信用分析相结合的方法, 挖掘相对价值被低估的债券, 构建分散化的投资组合。
业绩比较基准	美元一年银行定期存款利率（税后）+2%
风险收益特征	本基金为债券型基金, 属于证券投资基金中的中低风险品种, 其预期风险与收益高于货币市场基金, 低于混合型基金和股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 姓名	常克川	郭明

负责人	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798

## 2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	中文	美国北美信托银行有限公司
	英文	The Northern Trust Company
注册地址		50 South La Salle Street, Chicago, Illinois 60603 U.S.A.
办公地址		50 South La Salle Street, Chicago, Illinois 60603 U.S.A.
邮政编码		60603

## 2.5 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	南方基金管理股份有限公司	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2017 年 01 月 01 日-2017 年 12 月 31 日)	2016 年 03 月 03 日(基金合同生效日) - 2016 年 12 月 31 日
-------------------	---	---

	南方亚洲美元债 A	南方亚洲美元债 C	南方亚洲美元债 A	南方亚洲美元债 C
本期已实现收益	112,948,336.09	27,489,334.11	78,483,406.59	8,756,758.29
本期利润	-17,297,702.44	-19,406,807.99	188,557,977.16	22,599,674.00
加权平均基金份额本期利润	-0.0062	-0.0330	0.0582	0.0417
本期基金份额净值增长率	-0.94%	-1.45%	10.25%	9.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2017年12月31日)		报告期(2016年12月31日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0798	0.0700	0.0404	0.0362
期末基金资产净值	2,472,882,074.18	915,256,387.62	3,642,397,562.32	657,878,753.42
期末基金份额净值	1.0921	1.0823	1.1025	1.0983

注:1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方亚洲美元债 A

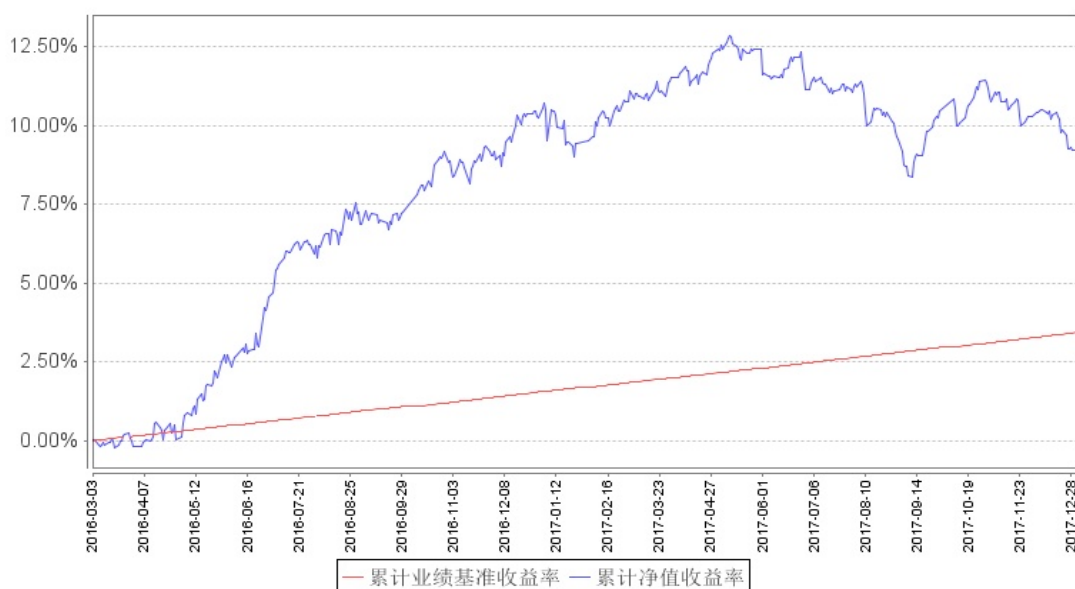
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.15%	0.17%	0.45%	0.00%	-1.60%	0.17%
过去六个月	-1.74%	0.17%	0.94%	0.00%	-2.68%	0.17%
过去一年	-0.94%	0.20%	1.85%	0.00%	-2.79%	0.20%
自基金合同	9.21%	0.21%	3.42%	0.00%	5.79%	0.21%

南方亚洲美元债 C

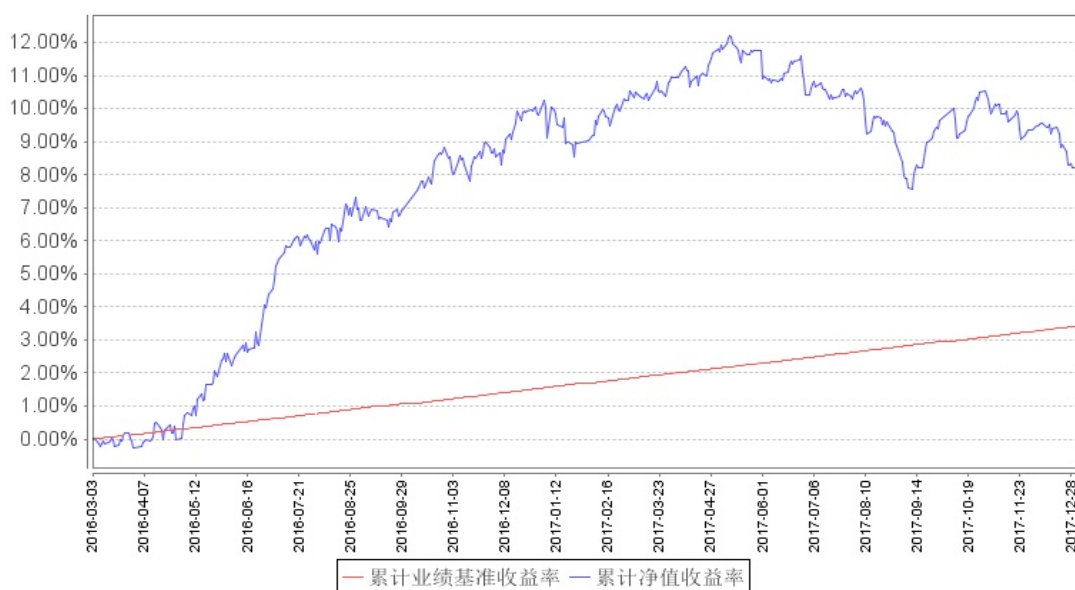
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.28%	0.17%	0.45%	0.00%	-1.73%	0.17%
过去六个月	-1.99%	0.17%	0.94%	0.00%	-2.93%	0.17%
过去一年	-1.45%	0.20%	1.85%	0.00%	-3.30%	0.20%
自基金合同	8.23%	0.21%	3.42%	0.00%	4.81%	0.21%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方亚洲美元债A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

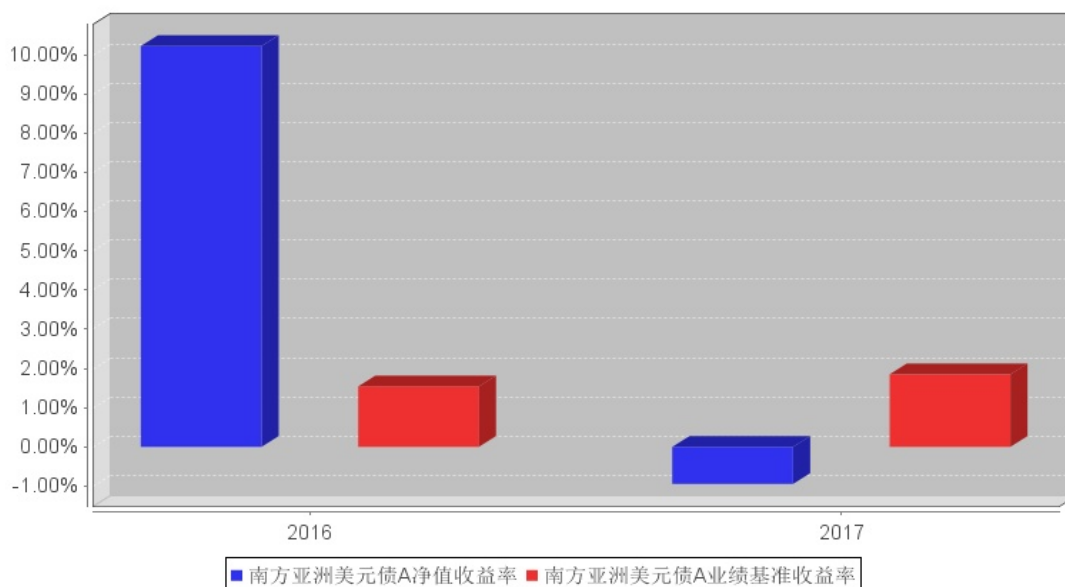


南方亚洲美元债C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

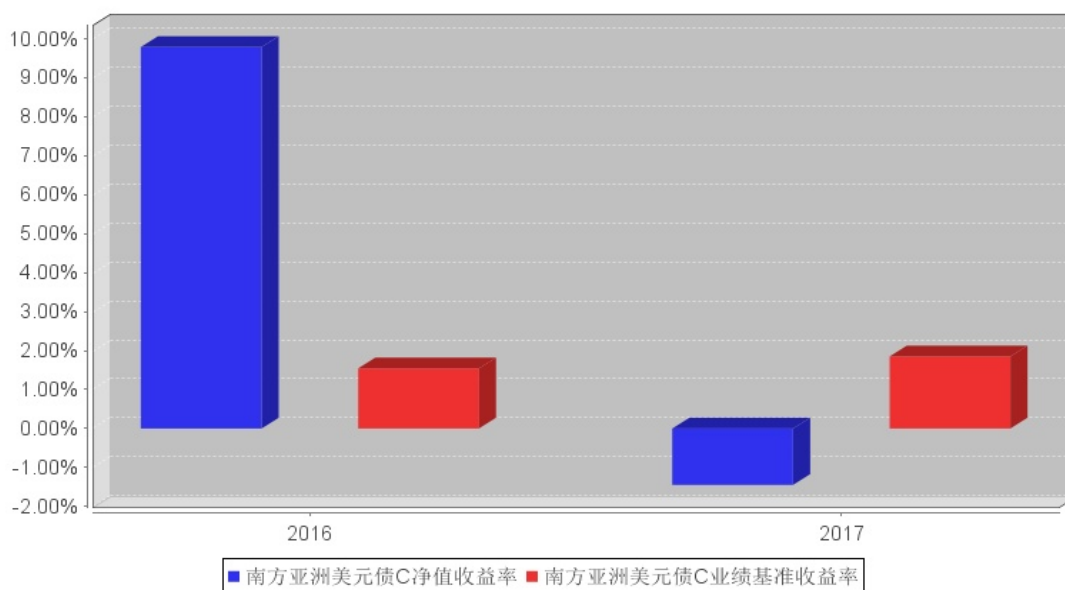


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方亚洲美元债A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



南方亚洲美元债C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司，注册资本金 3 亿元人民币。目前股权结构：华泰证券股份有限公司 45%、深圳市投资控股有限公司 30%、厦门国际信托有限公司 15%及兴业证券股份有限公司 10%。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超 7,200 亿元，旗下管理 153 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金和专户理财投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏炫纲	本基金 基金经 理	2016 年 3 月 3 日	-	15	台湾籍，美国印第安纳大学工商管理硕士，特许金融分析师（CFA），特许会计师（CPA），金融风险管理师（FRM），具有基金从业资格。11 年海外证券市场工作经验，曾任职于台湾大众银行、台湾美国商业银行、美国 Citadel Investment Group、台湾大华证券、台湾凯基证券，历任产品设计师、固定收益产品分析师、外汇与固定收益商品风险管理师、信用商品交易员等。2014 年 3 月加入南方基金，担任国际业务部基金经理助理；2016 年 3 月至今，任南方亚洲美元债基金经理。

注:1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。



2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方亚洲美元收益债券型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为5次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及指数型基金成份股调整所致，相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年全球经济继续复苏，但地缘政治事件（法国大选、德国议会选举、纽约恐袭、耶路撒冷风波、朝鲜局势等）都不断为市场带来扰动，受益于税改政策的落地和美联储 12 月议息会议的如期加息，叠加通胀情况改善，市场情绪有所提振，美债利率在年末也出现上行；但欧央行与日央行则仍旧按兵不动，并续维持原有政策利率。受益于大宗商品原材料价格的回升，亚洲经济增长也保持强劲，主要经济体净出口和国内消费需求均出现不同程度的改善，叠加国内改革和“一带一路”政策红利的释放，对经济的拉动效果明显。其中，泰国、马来西亚、菲律宾等经济体出现持续改善，而印度经济增速也在下半年开始逐渐回升，此前币制改革和营业税改革对私人消费的影响逐渐消退。虽然亚洲各经济体全年通胀水平虽略有抬升，但目前仍在央行政策区间的低位，因此多数经济体央行仍旧采取中性偏紧的政策态度。

但全年亚洲债市并不平静，区域内事件性风险仍然频发，不少高收益债相继出现实质性违约。尤其是受到来宝集团、印度 Reliance 集团、玉皇集团、如意集团等公司债暴跌的扰动，亚洲高收益债市场在年中出现恐慌性抛售，市场避险情绪被推高，债市流动性随之收紧。叠加穆迪、标普等国际评级机构轮番下调中国主权评级和超过 20 家境内机构的国际评级（主要涉及地方政府融资平台和部分国有企业），对投资级债市以及和中国主权评级紧密挂钩的发债主体的影响也非常明显。此外，随着国内金融去杠杆政策的持续，来自央行和发改委的监管也开始趋严，对市场（汇市和债市）的扰动进一步加剧。

持有期操作上，美元债基金上半年和下半年的收益差异较大，市场同类美元债基金中的收益分化也进一步扩大，而受益于谨慎和稳健的投资风格，即使面临亚洲债市事件性风险较高的局面，基金的美元份额收益依然继续保持稳健增长；人民币份额收益虽然受到汇率波动的影响，但也能在绝大多数时间内保持一定程度的正收益。此外，美元债基金组合仓位和债券集中度均较为分散，对风险的控制更加谨慎，全年信用债配置依旧集中在 AA-至 BBB-区间和 BBB-至 BB-区间；尤其在下半年，基金通过组合久期管理策略，灵活调整组合仓位比例（包括针对部分前期盈利的标的进行了减仓，并进一步增仓了投资级标的），降低了组合整体的风险敞口。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日，本基金 A 份额净值为 1.0921 元、C 份额净值为 1.0823。报告期内净值上涨分别为-0.94%、-1.45%，同期业绩基准为 1.85%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球经济在 2018 年仍将保持强劲的增长，美国目前位于经济周期的高点，欧洲则正在上升期，新兴市场也在不断改善，这将继续对收益率曲线形成支撑并提高无风险回报率。我们预计 2018 年上半年美债利率期限结构仍将保持平坦。美联储在 2018 年预计继续加息 3 次，2019 年和 2020 年均为 2 次，目前市场已经基本计入美联储明年上半年加息的影响，届时如期加息能对美债短端利率有所提振；虽然目前由于税改法案落地和通胀逐渐回升，美债长端利率出现上升，但地缘政治事件将继续给市场带来持续扰动，重新引发投资者的避险情绪，制约长端利率进一步攀升；因此，预计利率区间将缓慢上升，而市场交易机会仍然存在。目前来看，2018 年最大的市场风险是通胀的迅速回升，如果市场通胀突然上行或继续低迷，美联储均可及时作出调整。

汇率层面，目前美元指数走势与美国经济基本面表现出现背离，并未反映出美国经济恢复、真实投资收益率回升、全球资金净流入和美联储货币政策收紧等特点；短期而言，随着中美贸易关系将迎来挑战，汇率市场不确定性逐渐上升。但中长期而言，受益于美国经济基本面继续改善，叠加特朗普税改对经济增长的支撑，国际资本预计将加速回流美国，有利于美元需求端的改善，美元指数也将逐步出现估值修复；同时，叠加 2018-2019 年美联储加息预期的提升和兑现，对美元指数也将形成有效支撑。中国央行目前的调控方向仍然是对内保持经济平稳增长，对外促进出口增速；考虑到 2018 年国内经济增速放缓、美联储加息预期兑现以及中长期美元估值逐步修复的影响，我们预计人民币兑美元汇率将维持大区间波动。

2018 年上半年美元债仍将采取谨慎的策略，采用利率曲线策略，继续通过组合久期调整和仓位控制规避潜在的利率风险并提升组合收益，行业层面继续规避监管趋严的板块，区域层面依然在控制信用风险的前提下，继续维持“一带一路”的投资主线。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方

法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；基金收益分配币种与其对应份额的认购/申购币种相同；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为同一类别的基金份额进行再投资；美元认购/申购份额的红利再投资按所对应的美元折算净值为基准计算；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的人民币基金份额净值减去每单位该类别基金份额收益分配金额后不能低于人民币份额面值，但对于美元份额，由于汇率因素影响，存在收益分配后美元份额的基金份额净值低于对应的基金份额面值的可能；由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对南方亚洲美元收益债券型基金（QDII）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，南方亚洲美元收益债券型基金（QDII）的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方亚洲美元收益债券型基金（QDII）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面

的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，南方亚洲美元收益债券型基金（QDII）未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方亚洲美元收益债券型基金（QDII）2017 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

本基金 2017 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2018)第 22862 号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：南方亚洲美元收益债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	293,042,405.12	575,266,474.27
结算备付金		-	21,272,727.27
存出保证金		32,095,868.67	21,039,024.74
交易性金融资产	7.4.7.2	3,056,399,208.25	3,639,808,115.40
其中：股票投资		-	-
基金投资		124,542,153.60	-
债券投资		2,931,857,054.65	3,639,808,115.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	1,674,377.77	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		70,446.84	-
应收利息	7.4.7.5	33,368,762.73	34,526,402.18
应收股利		-	-

应收申购款		4,140,493.40	26,586,755.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	2,094,106.88
资产总计		3,420,791,562.78	4,320,593,606.08
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年12月31日</b>	<b>上年度末 2016年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	2,091,932.47
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		28,694,362.27	13,939,967.25
应付管理人报酬		2,443,431.29	2,881,880.45
应付托管费		671,943.64	792,517.13
应付销售服务费		399,207.55	266,528.52
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	444,156.23	344,464.52
负债合计		32,653,100.98	20,317,290.34
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	3,110,262,751.10	3,902,777,466.14
未分配利润	7.4.7.10	277,875,710.70	397,498,849.60
所有者权益合计		3,388,138,461.80	4,300,276,315.74
负债和所有者权益总计		3,420,791,562.78	4,320,593,606.08

注: 1. 报告截止日 2017 年 12 月 31 日, 基金份额总额 3,110,262,751.10 份, 其中, A 类(人民币)基金份额总额为 1,027,982,624.28 份, 基金份额净值为 1.0921 元; C 类(人民币)基金份额总额为 259,118,237.82 份, 基金份额净值为 1.0823 元; A 类(美元现汇)基金份额总额为 1,236,671,966.66 份, 基金份额净值为 0.1671 美元; C 类(美元现汇)基金份额总额为 586,489,922.34 份, 基金份额净值为 0.1656 美元。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体: 南方亚洲美元收益债券型证券投资基金

本报告期: 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2017年1月1日至 2017年12月31日	2016年03月03日（基 金合同生效日）至 2016年12月31日
一、收入		11,475,589.19	232,569,416.57
1. 利息收入		178,468,192.44	81,586,192.35
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,421,513.66	1,231,117.05
债券利息收入		176,379,695.03	79,500,961.64
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		666,983.75	854,113.66
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		28,618,938.75	1,100,412.48
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	51,487,881.06	828,277.20
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-23,323,940.86	272,135.28
股利收益	7.4.7.17	454,998.55	-
3. 公允价值变动收益	7.4.7.18	-177,142,180.63	123,917,486.28
4. 汇兑收益		-19,248,790.57	25,568,844.89
5. 其他收入	7.4.7.19	779,429.20	396,480.57
减：二、费用		48,180,099.62	21,411,765.41
1. 管理人报酬		32,262,882.35	15,585,665.45
2. 托管费		8,872,292.77	4,286,057.98
3. 销售服务费		4,693,192.91	1,159,758.50
4. 交易费用	7.4.7.20	1,920,532.06	45,030.48
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.21	431,199.53	335,253.00
三、利润总额		-36,704,510.43	211,157,651.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润		-36,704,510.43	211,157,651.16

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方亚洲美元收益债券型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,902,777,466.14	397,498,849.60	4,300,276,315.74

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-36,704,510.43	-36,704,510.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-792,514,715.04	-82,918,628.47	-875,433,343.51
其中：1. 基金申购款	2,436,034,492.36	262,800,808.33	2,698,835,300.69
2. 基金赎回款	-3,228,549,207.40	-345,719,436.80	-3,574,268,644.20
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,110,262,751.10	277,875,710.70	3,388,138,461.80
项目	上年度可比期间		
	2016年03月03日（基金合同生效日）至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,057,533,533.19	-	1,057,533,533.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	211,157,651.16	211,157,651.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	2,845,243,932.95	186,341,198.44	3,031,585,131.39
其中：1. 基金申购款	3,494,039,159.31	237,521,383.66	3,731,560,542.97
2. 基金赎回款	-648,795,226.36	-51,180,185.22	-699,975,411.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,902,777,466.14	397,498,849.60	4,300,276,315.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

杨小松

徐超

徐超

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人



## 7.4 报表附注

### 7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

#### 7.4.1.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.1.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税(于2016年5月1日前)或增值税(自2016年5月1日起至2017年12月31日止)且暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

### 7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构

美国北美信托银行有限公司（“北美信托银行”）	境外资产托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《南方基金管理有限公司法定名称变更的公告》，公司名称由“南方基金管理有限公司”变更为“南方基金管理股份有限公司”，公司股权结构等事项未发生变化，并已于 2018 年 1 月 4 日在深圳市市场监督管理局完成相应变更登记手续。

#### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.4.1.1 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 03 月 03 日（基金合同生效日） 至 2016 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）
华泰证券	80,000,000.00	9.41	-	-

##### 7.4.4.2 关联方报酬

###### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 03 月 03 日（基金 合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	32,262,882.35	15,585,665.45
其中：支付销售机构的客户维护费	11,043,975.22	5,145,065.35

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

#### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年03月03日（基金 合同生效日）至2016年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,872,292.77	4,286,057.98

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.22%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

#### 7.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方亚洲美元债C类人民 币	南方亚洲美元债C类美元 现汇	合计
南方基金	106,004.04	-	106,004.04
中国工商银行	406,391.35	28,463.79	434,855.14
华泰证券	49,531.09	-	49,531.09
兴业证券	895.65	-	895.65
合计	562,822.13	28,463.79	591,285.92
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2016年03月03日（基金合同生效日）至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方亚洲美元债C类人民 币	南方亚洲美元债C类美元 现汇	合计
南方基金	41,514.87	-	41,514.87
中国工商银行	104,698.69	174,127.57	278,826.26
华泰证券	33,004.90	-	33,004.90
兴业证券	737.26	-	737.26

合计	179,955.72	174,127.57	354,083.29
----	------------	------------	------------

注：支付销售机构的 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.50% 的费率计提，每日计提，按月支付。由本基金的基金管理人南方基金向本基金的基金托管人中国工商银行发送划付指令，经中国工商银行复核后从基金财产中一次性支付给各销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

#### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

南方亚洲美元债 A

关联方名称	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
兴业证券	50,017,472.22	4.87%	50,017,472.22	2.13%

注：兴业证券投资本基金相关的费用按基金合同和更新的招募说明书的有关规定支付。

##### 7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 03 月 03 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	182,101,321.18	860,295.68	122,960,034.27	1,189,679.55
北美信托银行	110,941,083.94	549,213.30	452,306,440.00	-
合计	293,042,405.12	1,409,508.98	575,266,474.27	1,189,679.55

##### 7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 7.4.5 利润分配情况

##### 7.4.5.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.6 期末(2017 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券流通受限证券。

##### 7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	124,542,153.60	3.64
3	固定收益投资	2,931,857,054.65	85.71
	其中：债券	2,931,857,054.65	85.71
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	1,674,377.77	-
	其中：远期	-	-
	期货	1,674,377.77	0.05
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	293,042,405.12	8.57
8	其他各项资产	69,675,571.64	2.04
9	合计	3,420,791,562.78	100.00

## 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币

元

债券信用等级	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
A+至 A-	247,878,013.41	7.32
BBB+至 BBB-	1,226,632,780.66	36.20
BB+至 BB-	1,241,009,566.31	36.63
B+至 B-	59,994,557.09	1.77
其它	156,342,137.18	4.61
总计	2,931,857,054.65	86.53

注：本债券投资组合主要采用标准普尔、穆迪等机构提供的债券信用评级信息，未提供评级信息的可适用内部评级。

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	XS1122780106	BCHINA 6 3/4 10/31/49 CORP	1,740,000	193,918,867.50	5.72
2	XS1326527246	BNKEA 5 1/2 12/29/49	266,950	178,093,508.85	5.26
3	XS1165659514	HRAM 5 1/2 01/16/25	240,000	169,904,359.34	5.01
4	XS1489734746	UNILIC 3 09/19/21	260,000	162,517,707.61	4.80

5	XS1452359521	OLAMSP 5.35 12/29/49	170,000	111,262,462.68	3.28
---	--------------	-------------------------	---------	----------------	------

## 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	期货	CBT 10Y	1,674,377.77	0.05

## 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	iShares 安硕 TIPS ETF	ETF 基金	开放式	BlackRock Fund Advisors(贝莱德基金管理公司)	74,542,153.60	2.20
2	信达澳银慧管家货币 C	货币型基金	开放式	信达澳银基金管理有限公司	50,000,000.00	1.48

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	32,095,868.67
2	应收证券清算款	70,446.84
3	应收股利	-
4	应收利息	33,368,762.73
5	应收申购款	4,140,493.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	69,675,571.64

#### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额 比例 (%)
南方亚洲 美元债 A	20,073	112,820.93	410,740,777.83	18.14%	1,853,913,813.11	81.86%
南方亚洲 美元债 C	47,914	17,648.46	6,434,339.02	0.76%	839,173,821.14	99.24%
合计	67,987.00	45,747.90	417,175,116.85	13.41%	2,693,087,634.25	86.59%

注:分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
----	------	-----------	-------------



基金管理人 所有从业人 员持有本基 金	南方亚洲美元债 A	4,032,453.51	0.1781
	南方亚洲美元债 C	602,827.81	0.0713
	合计	4,635,281.32	0.1490

注：：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、 基金投资和研 究部门负责 人持有本开 放式基金	南方亚洲美元债 A	0
	南方亚洲美元债 C	0
	合计	0
本基金基金经 理持有本开 放式基金	南方亚洲美元债 A	>100
	南方亚洲美元债 C	0
	合计	>100

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方亚洲美元债 A	南方亚洲美元债 C
基金合同生效日 (2016年3月3日) 基金份额总额	959,440,960.16	98,092,573.03
本报告期期初基金份 额总额	3,303,780,975.63	598,996,490.51
本报告期基金总申购 份额	1,563,759,639.14	872,274,853.22
减：本报告期基金总 赎回份额	2,602,886,023.83	625,663,183.57
本报告期基金拆分变 动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-
本报告期期末基金份 额总额	2,264,654,590.94	845,608,160.16

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2017 年 1 月 23 日南方基金管理有限公司第七届董事会第二次会议，审议通过秦长奎因任期届满，工作调整的原因不再担任公司副总经理职务。

2017 年 12 月 8 日南方基金管理股份有限公司（筹）第一届董事会第一次会议，审议通过聘任史博担任公司副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 130,000.00 元。该审计机构第 2 年为该基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	-
KGI Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs (Asia)L.L.C	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse(Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Co.,Ltd	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific)Limited	-	-	-	-	-	-
Barclays Bank	-	-	-	-	-	-
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch (Asia Pacific) Ltd	-	-	-	-	-	-
ICBC International Securities Limited	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities International Company	-	-	-	-	-	-

Limited						
BNP Paribas Corporate & Investment Banking	-	-	-	-	-	-
CITI Group Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-
星展唯高达香港	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered Bank (Hong Kong) Ltd	-	-	-	-	-	-
银河证券	1					
华泰证券	1	-	-	-	-	-
Nomura (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
SC Lowy	-	-	-	-	-	-
Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited						
Mizuho Securities Asia Ltd						
Credit Agricole						
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-

注：1、为节约交易单元资源，我公司在交易所交易系统升级的基础上，对同一银行托管基金进行了席位整合。

2、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

A：选择标准

(a) 公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；

(b) 公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告;

(c) 公司内部管理规范,能满足基金操作的保密要求;

(d) 建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

#### B: 选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比,并根据评比的结果选择席位:

(a) 服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座;

(b) 研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实,投资建议是否准确;

(c) 资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
BOCI Securities Limited	618,763,232.66	7.16%	-	-		
KGI Asia Limited	141,448,702.13	1.64%	-	-		
Morgan Stanley Asia Limited	548,856,977.90	6.35%	-	-		
Goldman Sachs (Asia)L.L.C	1,015,001,922.17	11.75%	-	-	75,223,387.44	100%
Credit Suisse (Hong Kong) Limited	214,876,566.17	2.49%	-	-		
Haitong International Securities Co.,Ltd	267,433,386.48	3.10%	-	-		

J. P. Morgan Securities (Asia Pacific)Limited	254,776,333.08	2.95%	-	-		
Barclays Bank	526,501,494.62	6.09%				
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	863,060,981.63	9.99%	-	-		
Merrill Lynch (Asia Pacific) Ltd	220,896,678.63	2.56%	-	-		
ICBC International Securities Limited	79,058,964.30	0.92%	-	-		
Guotai Junan (Hong Kong) Limited	109,653,669.33	1.27%	-	-		
CITIC Securities International Company Limited	312,033,316.49	3.61%	-	-		
BNP Paribas Corporate & Investment Banking	415,014,837.06	4.80%	-	-		
CITI Group Global Markets Asia Limited	910,361,741.97	10.54%	-	-		
星展唯高达香港	362,253,760.74	4.19%	-	-		
UBS Securities Asia Limited	512,958,159.38	5.94%	-	-		
Standard Chartered Bank (Hong Kong) Ltd	411,579,720.20	4.76%	-	-		
银河证券			770,000,000.00	90.59%		
华泰证券			80,000,000.00	9.41%		
Nomura (Hong Kong) Limited	34,085,593.52	0.39%	-	-		

SC Lowy	366,684,434.60	4.24%	-	-		
Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited	75,994,448.96	0.88%	-	-		
Mizuho Securities Asia Ltd	266,315,298.67	3.08%	-	-		
Credit Agricole	76,637,967.56	0.89%	-	-		
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	34,996,020.16	0.41%	-	-		

注：交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。